广发集丰债券型证券投资基金 2017年年度报告摘要

2017年12月31日
基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发集丰债券	
基金主代码	002711	
交易代码	002711	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月1日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	214,103,196.72份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发集丰债券A	广发集丰债券C
下属分级基金的交易代码	002711	002712
报告期末下属分级基金的份额总额	213,930,542.39份	172,654.33份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注经济、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并按服务因素的动态变化进行及时调整。
业绩比较基准	中债总全价指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	田静
	联系电话	020-83936666	(010)67594096
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	tianjing1.zh@ccb.com
客户服务电话		95105828; 020-83936999	010-67595096
传真		020-88969158	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年		2016年11月1日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	广发集丰债券A	广发集丰债券C	广发集丰债券A	广发集丰债券C
本期已实现收益	9,901,902.42	5,986.96	678,276.00	1,052.00
本期利润	14,563,470.74	5,944.70	-414,865.40	-1,188.09
加权平均基金份额本期利润	0.0491	0.0295	-0.0021	-0.0029
本期加权平均净值利润率	4.83%	2.91%	-0.21%	-0.29%
本期基金份额净值增长率	5.50%	5.20%	-0.20%	-0.30%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末	
	广发集丰债券A	广发集丰债券C	广发集丰债券A	广发集丰债券C
期末可供分配基金份额利润	0.0011	0.0017	-0.0021	-0.0029
期末基金资产净值	217,915,562.70	175,955.76	201,037,848.57	411,796.46
期末基金份额净值	1.019	1.019	0.998	0.997

注：(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(3)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发集丰债券A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.12%	0.29%	-1.42%	0.09%	3.54%	0.20%
过去六个月	3.73%	0.21%	-1.84%	0.07%	5.57%	0.14%
过去一年	5.50%	0.15%	-4.26%	0.09%	9.76%	0.06%
自基金合同生效起至今	5.29%	0.14%	-6.90%	0.12%	12.19%	0.02%

2、广发集丰债券C：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.53%	0.29%	-1.42%	0.09%	3.95%	0.20%
过去六个月	3.84%	0.20%	-1.84%	0.07%	5.68%	0.13%
过去一年	5.20%	0.15%	-4.26%	0.09%	9.46%	0.06%
自基金合同生效起至今	4.88%	0.14%	-6.90%	0.12%	11.78%	0.02%

注：业绩比较基准：中债总全价指数收益率。

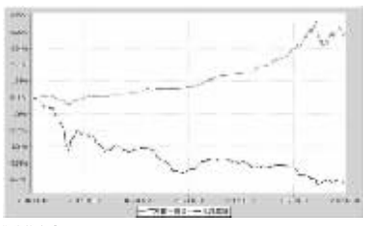
3.2.2 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集丰债券型证券投资基金

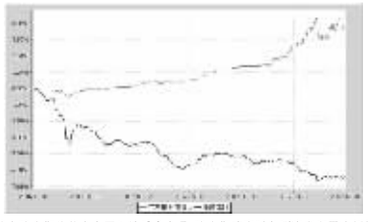
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年11月1日至2017年12月31日)

1、广发集丰债券A



2、广发集丰债券C



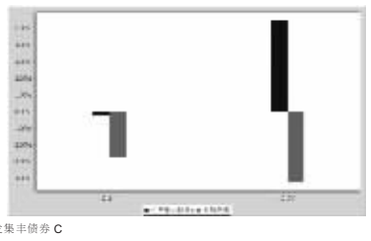
注：本基金建仓期为基金合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

3.2.3 基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

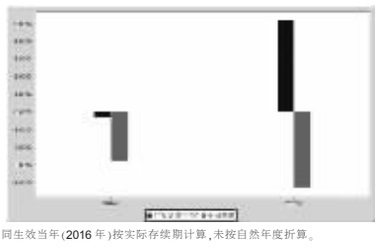
广发集丰债券型证券投资基金

净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1、广发集丰债券A



2、广发集丰债券C



注：合同生效当年(2016年)按实际存续期计算，未按自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、广发集丰债券A：

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017年	0.340	29,391.38	7,011,004.41	7,040,395.79	-
合计	0.340	29,391.38	7,011,004.41	7,040,395.79	-

2、广发集丰债券C：

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017年	0.300	2,573.78	2,531.61	5,105.39	-
合计	0.300	2,573.78	2,531.61	5,105.39	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理(QDII)等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和29个部门：权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金与战略业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司(香港子公司)，参股了证通股份有限公司。

截至2017年12月31日，本基金管理人管理161只开放式基金，管理资产规模为2799亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资和养老基金投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张平	本基金的基金经理;广发稳健债券基金的基金经理;广发聚鑫债券基金的基金经理;广发集惠债券基金的基金经理;广发集裕债券基金的基金经理;广发集裕纯债债券基金的基金经理;广发集和纯债债券基金的基金经理;广发集利纯债债券基金的基金经理;广发集瑞纯债债券基金的基金经理;广发集丰纯债债券基金的基金经理;广发集益纯债债券基金的基金经理;广发集盈纯债债券基金的基金经理;广发集泰纯债债券基金的基金经理;广发集兴纯债债券基金的基金经理;广发集祥